

# 工银理财·“全鑫权益”私银尊享量化策略理财产品HHPB1901 (HHPB1901) 2020年年报

| 1、重要提示                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                        |               |               |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|
| 无                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                        |               |               |
| 2、理财产品概况                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                        |               |               |
| 产品名称                                                                                                                                                                                                                                                  | 工银理财·“全鑫权益”私银尊享量化策略理财产品HHPB1901                                                                        |               |               |
| 产品代码                                                                                                                                                                                                                                                  | HHPB1901                                                                                               |               |               |
| 销售币种                                                                                                                                                                                                                                                  | 人民币                                                                                                    |               |               |
| 产品风险评级                                                                                                                                                                                                                                                | PR3                                                                                                    |               |               |
| 收益类型                                                                                                                                                                                                                                                  | 非保本浮动收益                                                                                                |               |               |
| 产品成立日                                                                                                                                                                                                                                                 | 2019年07月11日                                                                                            |               |               |
| 产品到期日                                                                                                                                                                                                                                                 | 2022年07月11日                                                                                            |               |               |
| 业绩比较基准                                                                                                                                                                                                                                                | 本产品为净值型产品，其业绩表现将随市场波动，具有不确定性。本产品业绩比较基准为4.5%-5.50%（年化），该业绩比较基准仅作为计算浮动管理费的依据，不构成工银理财有限责任公司对该理财产品的任何收益承诺。 |               |               |
| 托管费率（年）                                                                                                                                                                                                                                               | 0.02%                                                                                                  |               |               |
| 销售手续费率（年）                                                                                                                                                                                                                                             | 0.50%                                                                                                  |               |               |
| 杠杆水平                                                                                                                                                                                                                                                  | 100%                                                                                                   |               |               |
| 产品托管人                                                                                                                                                                                                                                                 | 工商银行北京分行                                                                                               |               |               |
| 报告期末理财产品份额                                                                                                                                                                                                                                            | 92,697,000.00                                                                                          |               |               |
| 3、产品净值表现                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                        |               |               |
| 截至2020年12月31日，产品净值为1.17,累计净值为1.17,产品资产净值108454967.56,产品年化收益率为11.49%,超过业绩基准                                                                                                                                                                            |                                                                                                        |               |               |
| 4、市场情况及产品运作回顾                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                        |               |               |
| 4.1、市场回顾                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                        |               |               |
| 市场方面，2020年受疫情影响，市场宽幅波动，十年期国债中债估值到期收益率先下后上，先有3.12%下行至最低2.47%，之后又上行回到3.15%；A股方面年初大幅波动，全年市场整体上涨，上证综指涨14.2%，沪深300指数涨27.7%，创业板指涨65.7%。A股行业板块表现分化，涨幅前三位的中信一级行业为食品饮料、电力设备及新能源、消费者服务；跌幅前三位的中信一级行业为综合金融、房地产、通信。商品市场方面，上海黄金交易所现货黄金（AU9999）上涨14.3%，南华商品指数上涨7.4%。 |                                                                                                        |               |               |
| 4.2、操作回顾                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                        |               |               |
| 根据市场波动情况，及时调整产品内资产持仓，运用大类资产配置方案、多资产投资、多策略投资的方式进行灵活调整，把握市场波动机会，稳健提升产品收益                                                                                                                                                                                |                                                                                                        |               |               |
| 4.3、下一步投资策略                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                        |               |               |
| 结合产品净值情况，结合大类资产配置方案和市场数据，参照产品期限调整产品仓位，在市场低位适当增加风险资产比例，运用止盈、止损、分散化投资等方式控制回撤                                                                                                                                                                            |                                                                                                        |               |               |
| 5、投资组合报告                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                        |               |               |
| 5.1投资组合概况                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                        |               |               |
| 本产品直接投资的资产比例为15.39%，间接投资的比例为84.61%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类54.71%、权益类21.46%、商品及衍生品类23.83%。                                                                                                                                                             |                                                                                                        |               |               |
| 5.2投资组合基本情况                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                        |               |               |
| 序号                                                                                                                                                                                                                                                    | 资产种类                                                                                                   | 占投资组合的比例（%）期末 | 占投资组合的比例（%）期初 |
| ※                                                                                                                                                                                                                                                     | 固定收益类                                                                                                  | 45.62%        | --            |

|    |       |        |    |
|----|-------|--------|----|
|    | 货币类   | 15.39% | -- |
|    | 债券类   | 30.23% | -- |
| ※  | 混合类资产 | 54.38% | -- |
|    | 对冲基金类 | 54.38% | -- |
| 合计 |       | 100%   | -- |

### 5.3 产品投资前十项资产明细

| 序号 | 资产名称               | 规模          | 规模占比(%) |
|----|--------------------|-------------|---------|
| 1  | 国信证券稳1号集合资产管理计划    | 33162000.00 | 30.23%  |
| 2  | 工银量化永安国富1期         | 32328400.00 | 29.47%  |
| 3  | 东证期货工银慧享二号集合资产管理计划 | 27318000.00 | 24.90%  |
| 4  | 活期存款               | 16882575.86 | 15.39%  |

### 5.4 产品投资前十名债券明细

| 债券代码 | 债券名称 | 占投资组合的比例(%) |
|------|------|-------------|
| 无    |      |             |

### 5.5 产品投资前十名股票明细

| 股票代码 | 股票名称 | 占投资组合的比例(%) |
|------|------|-------------|
| 无    |      |             |

### 5.6 报告期末产品投资非标准化债权类资产明细

| 序号 | 融资客户 | 投资品名称 | 剩余融资期限(月) | 投资品年收益率(%) | 投资模式 | 是否存在风险 | 占投资组合的比例(%) |
|----|------|-------|-----------|------------|------|--------|-------------|
| 无  |      |       |           |            |      |        |             |

### 5.7 投资组合流动性风险分析

无

### 6、其他重要信息

报告期内投资于工银瑞信基金管理有限公司发行的工银金融地产股票(证券代码: 000251.OF), 交易数量为472361.29, 单位价格为2.144, 标的资产类别为基金

报告期内投资于腾讯控股有限公司发行的腾讯控股(证券代码: 0700.HK), 交易数量为6623.28, 单位价格为498.6, 标的资产类别为股票

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19融和02(证券代码: 151621.SH), 交易数量为2855.8, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19首钢02(证券代码: 151857.SH), 交易数量为9519.32, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19常城03(证券代码: 162026.SH), 交易数量为4759.66, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19华通01(证券代码: 162700.SH), 交易数量为4759.66, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20津投03(证券代码: 163146.SH), 交易数量为3807.73, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20津资D1(证券代码: 166148.SH), 交易数量为4759.66, 单位价格为100, 标的资产类别为债券